

Assenagon I

Ungeprüfter Halbjahresbericht zum 31. März 2023

– Anlagefonds nach Luxemburger Recht –

"Fonds commun de placement" ("FCP") gemäß Teil I des Luxemburger Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen

R.C.S.-Nr. K80

Der vorliegende Bericht für den Umbrella-Fonds

"Assenagon I"

umfasst folgenden Teilfonds:

- Assenagon I - Multi Asset Conservative
- Assenagon I - Multi Asset Balanced

Inhalt

Informationen an die Anleger	2
Verwaltung, Vertrieb und Beratung	3
Assenagon I – Multi Asset Conservative	4
Zusammensetzung des Netto-Teilfondsvermögens	4
Währungsübersicht des Teilfonds	4
Wertpapierkategorie-Übersicht des Teilfonds.....	4
Länderübersicht des Wertpapiervermögens des Teilfonds.....	5
Vermögensaufstellung des Teilfonds	5
Verpflichtungen aus Derivaten.....	9
Devisenkurse (in Mengennotiz)	9
Ertrags- und Aufwandsrechnung des Teilfonds.....	10
Vermögensentwicklung des Teilfonds.....	11
Entwicklung im Jahresvergleich.....	11
Assenagon I – Multi Asset Balanced	12
Zusammensetzung des Netto-Teilfondsvermögens	12
Währungsübersicht des Teilfonds	12
Wertpapierkategorie-Übersicht des Teilfonds.....	12
Länderübersicht des Wertpapiervermögens des Teilfonds.....	13
Vermögensaufstellung des Teilfonds	13
Verpflichtungen aus Derivaten.....	16
Devisenkurse (in Mengennotiz)	17
Ertrags- und Aufwandsrechnung des Teilfonds.....	18
Vermögensentwicklung des Teilfonds.....	19
Entwicklung im Jahresvergleich.....	19
Zusammenfassung des Assenagon I	20
Zusammensetzung des Netto-Fondsvermögens.....	20
Vermögensentwicklung des Fonds.....	20
Ertrags- und Aufwandsrechnung des Fonds.....	21
Anhang zum ungeprüften Halbjahresbericht	22
Zusatzinformationen für Anleger in der Schweiz	28

Informationen an die Anleger

Die Jahresberichte, inklusive geprüften Jahresabschlüssen werden spätestens vier Monate nach Ablauf eines jeden Geschäftsjahres und die ungeprüften Halbjahresberichte spätestens zwei Monate nach Ablauf der ersten Hälfte des Geschäftsjahres veröffentlicht.

Das Geschäftsjahr des Fonds beginnt am 1. Oktober eines jeden Jahres und endet am 30. September des darauffolgenden Jahres.

Zeichnungen können nur auf Basis des jeweils gültigen Verkaufsprospektes (nebst Anhängen) und wesentlichen Anlegerinformationen bzw. Basisinformationsblätter, sowie mit dem zuletzt erschienenen Jahresbericht und, wenn der Stichtag des letzteren länger als acht Monate zurückliegt, zusätzlich mit dem jeweils aktuellen Halbjahresbericht, erfolgen.

Die Berichte sowie der jeweils gültige Verkaufsprospekt/Emissionsdokument (nebst Anhängen) und wesentlichen Anlegerinformationen bzw. Basisinformationsblätter sind bei der Verwahrstelle, der Verwaltungsgesellschaft und den Zahl- und Informationsstellen kostenlos erhältlich.

Die Assenagon Asset Management S.A. bestätigt, sich während des Berichtszeitraums in ihrer Tätigkeit für den Fonds in allen wesentlichen Belangen an die von der ALFI im "ALFI Code of Conduct for Luxembourg Investment Funds" von 2009 (in der letzten Fassung vom Juni 2013) festgelegten Grundsätze gehalten zu haben.

Zusätzliche Informationen für die Schweiz

Der Prospekt, das Basisinformationsblatt, das Fondsreglement, die jährlichen und halbjährlichen Berichte auf Deutsch, sowie weitere Informationen sind kostenlos beim Vertreter in der Schweiz erhältlich: Carnegie Fund Services S.A., 11, Rue du Général-Dufour, 1204 Genf, Schweiz, Tel.: + 41 22 705 1177, Fax: + 41 22 705 1179, Web: www.carnegie-fund-services.ch. Zahlstelle in der Schweiz ist Banque Cantonale de Genève, 17, Quai de l'Île, 1204 Genf, Schweiz. Die aktuellen Anteilspreise können unter www.fundinfo.com abgerufen werden.

Verwaltung, Vertrieb und Beratung

Verwaltungsgesellschaft

Assenagon Asset Management S.A.
Aerogolf Center
1B Heienhaff
1736 Senningerberg
Luxemburg
www.assenagon.com

Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft

Hans Günther Bonk (Vorsitzender)
Vassilios Pappas
Dr. Dr. Heimo Plössnig
KoppaKontor GmbH, vertreten durch Dr. Immo Querner

Geschäftsführer der Verwaltungsgesellschaft

Dr. Stephan Höcht
Matthias Kunze
Jens Meiser (seit dem 12. Dezember 2022)
Dr. Dr. Heimo Plössnig
Thomas Romig
Philip Seegerer

Zentralverwaltungsstelle

Apex Fund Services S.A.
3, rue Gabriel Lippmann
5365 Munsbach
Luxemburg
www.apexfundservices.com

Verwahrstelle sowie Register- und Transferstelle *)

European Depositary Bank SA
3, rue Gabriel Lippmann
5365 Munsbach
Luxemburg
www.europeandepositorybank.com

Register- und Transferstelle *)

Apex Fund Services S.A.
3, rue Gabriel Lippmann
5365 Munsbach
Luxemburg
www.apexfundservices.com

Zahlstelle im Großherzogtum Luxemburg

European Depositary Bank SA
3, rue Gabriel Lippmann
5365 Munsbach
Luxemburg
www.europeandepositorybank.com

Aufsichtsbehörde im Großherzogtum Luxemburg

Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF)
283, Route d'Arlon
2991 Luxemburg
Luxemburg
www.cssf.lu

Kontaktstelle für die Bundesrepublik Deutschland und die Republik Österreich

Assenagon Asset Management S.A.
Aerogolf Center
1B Heienhaff
1736 Senningerberg
Luxemburg
www.assenagon.com

Vertriebs- und Informationsstelle für die Bundesrepublik Deutschland und Informationsstelle für die Republik Österreich

Assenagon Asset Management S.A.
Zweigniederlassung München
Prannerstraße 8
80333 München
Deutschland
www.assenagon.com

Steuerlicher Vertreter in der Republik Österreich

PricewaterhouseCoopers Österreich GmbH
Erdbergstraße 200
1030 Wien
Österreich
www.pwc.com/at

Zahlstelle in der Schweiz

BANQUE CANTONALE DE GENÈVE
17, quai de l'Île
1204 Genf
Schweiz
www.bcge.ch

Vertreter in der Schweiz

CARNEGIE FUND SERVICES S.A.
11, rue du Général-Dufour
1204 Genf
Schweiz
www.carnegie-fund-services.ch

Abschlussprüfer

Deloitte Audit, Société à responsabilité limitée
20 Boulevard de Kockelscheuer
1821 Luxemburg
Luxemburg
www.deloitte.lu

Assenagon I – Multi Asset Conservative

Zusammensetzung des Netto-Teilfondsvermögens

Assenagon I – Multi Asset Conservative per 31. März 2023

Position	Betrag in EUR
Wertpapiervermögen	324.346.900,36
(Wertpapiereinstandskosten EUR 322.565.961,02)	
Derivate	3.168.144,56
Bankguthaben	71.393.000,38
Sonstige Vermögensgegenstände	18.655,56
Summe Aktiva	398.926.700,86
Bankverbindlichkeiten	-5.011.098,03
Zinsverbindlichkeiten	-513,14
Sonstige Verbindlichkeiten	-393.871,79
Summe Passiva	-5.405.482,96
Netto-Teilfondsvermögen	393.521.217,90

Währungsübersicht des Teilfonds

Assenagon I – Multi Asset Conservative

Währung	Kurswert in Mio. EUR	In % des Netto- Teilfondsvermögens
EUR	366,27	93,06
USD	19,46	4,94
GBP	2,23	0,57
CHF	1,29	0,33
CAD	1,24	0,32
HKD	1,05	0,27
NOK	0,97	0,25
SEK	0,97	0,25
JPY	0,04	0,01
Summe	393,52	100,00

Wertpapierkategorie-Übersicht des Teilfonds

Assenagon I – Multi Asset Conservative

Wertpapierkategorie	Kurswert in Mio. EUR	In % des Netto- Teilfondsvermögens
Wertpapier-Investmentanteile	308,91	78,50
Indezertifikate	14,60	3,71
Aktien	0,84	0,21
Summe	324,35	82,42

Länderübersicht des Wertpapiervermögens des Teilfonds

Assenagon I – Multi Asset Conservative

Länder	Kurswert in Mio. EUR	In % des Netto- Teilfondsvermögens
Luxemburg	154,85	39,34
Irland	124,63	31,67
Frankreich	36,07	9,17
Liechtenstein	3,57	0,91
Bundesrepublik Deutschland	3,45	0,88
Kanada	0,94	0,24
Jersey	0,84	0,21
Summe	324,35	82,42

Vermögensaufstellung des Teilfonds

Assenagon I – Multi Asset Conservative zum 31. März 2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Notierung	Bestand	Kurs zum 31.03.2023	Kurswert in EUR	In % des Netto- Teilfonds- vermögens
Amtlich gehandelte Wertpapiere/Regulierter Markt						
Indezertifikate						
Invesco Physical Markets PLC ETC 31.12.2100 Gold	IE00B579F325	STK	80.000,00 EUR	175,8700	14.069.600,00	3,58
iShares Physical Metals PLC OPEN END ZT 11(11/O.End) Platin	IE00B4LHWP62	STK	40.000,00 USD	14,3200	527.221,69	0,13
Organisierter Markt						
Aktien						
Yellow Cake PLC Registered Shares LS-,01	JE00BF50RG45	STK	200.000,00 GBP	3,6920	840.332,31	0,21
Wertpapier-Investmentanteile						
Sprott Physical Uranium Trust Registered Units o.N.	CA85210A1049	ANT	90.000,00 CAD	15,4100	943.244,81	0,24
A.I.I.S.-All.Europ.MicroCap Inhaber-Ant. IT (EUR)Acc. o.N.	LU0594339896	ANT	245,00 EUR	3.863,5900	946.579,55	0,24
Am.Fds-Amundi Fds Volatil.Euro Nam.-Ant. I EUR(C) oN	LU0272941112	ANT	1.300,00 EUR	1.348,2900	1.752.777,00	0,45
Amundi Fds-Europ. Equity Value Act.Nom. I2 Unh. EUR Acc. oN	LU1883315480	ANT	1.100,00 EUR	2.457,3000	2.703.030,00	0,69
Assenagon Alpha Volatility Nam.-Ant. I o.N.	LU0575255335	ANT	6.000,00 EUR	1.155,4200	6.932.520,00	1,76
AXA IM F.I.I.S.-US Sh.Dur.H.Y. Nam.-Ant. A(Cap.)EUR o.N.	LU0194345913	ANT	87.000,00 EUR	170,5900	14.841.330,00	3,77
BAKERSTEEL GBL - Electrum Fund Act. au Port. I EUR Acc. oN	LU1923360827	ANT	250,00 EUR	164,4600	41.115,00	0,01
Berenberg European Micro Cap Nam.-Ant. M o.N.	LU1637618825	ANT	2.000,00 EUR	152,5600	305.120,00	0,08
BNP Paribas EO H.Yld S.Dur.Bd Act. Nom. I H EUR Cap o.N.	LU1022395633	ANT	120.000,00 EUR	117,3400	14.080.800,00	3,58
Brown Adv Btl Gdmn US Val Reg. Shs SIUH EUR Acc. oN	IE00BN940Q96	ANT	800.000,00 EUR	10,6900	8.552.000,00	2,17
Eleva UCITS-Eleva Abs.Ret.Eur. Nam.-Ant. S EUR acc. o.N.	LU1331974276	ANT	6.000,00 EUR	1.449,2600	8.695.560,00	2,21
F.Sent.Inv.Gl.U.-FSSA Jap.Equ. Reg. Shs VI EUR Acc. oN	IE00BFY84Q86	ANT	130.000,00 EUR	20,0030	2.600.390,00	0,66
Fed.He.IF-F.H.As.Ex-Jap.Equ.Fd Reg. Shs F Dist.EUR o.N.	IE00B831WC11	ANT	1.890.000,00 EUR	4,4727	8.453.403,00	2,15
Flossbach von Storch-Bd Oppor. Inhaber-Anteile IT o.N.	LU1481584016	ANT	208.000,00 EUR	115,1300	23.947.040,00	6,09
Fulcrum-Eq.Dispersion Fund Act. Nom. I EUR Acc. oN	LU2164655040	ANT	17.000,00 EUR	115,6351	1.965.796,70	0,50
Fundsmith SICAV-Equity Fund Nam.-Ant. I Dis.o.N.	LU0690374532	ANT	260.000,00 EUR	51,0655	13.277.030,00	3,37
Helium Fd-Helium Performance Act.-Nom. S Cap. EUR o.N.	LU0912262358	ANT	850,00 EUR	1.443,0470	1.226.589,95	0,31
HELIUM FDS-HELIUM INVEST Act. Nom. D Uhd EUR Acc. oN	LU1995646509	ANT	1.250,00 EUR	1.247,4220	1.559.277,50	0,40

Die Notierung der Wertpapiere erfolgt in Stücken, bzw. Anteilen, bzw. in Währung in 1.000.
Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichtes.

Gattungsbezeichnung	ISIN	Notierung	Bestand		Kurs zum 31.03.2023	Kurswert in EUR	In % des Netto- Teilfonds- vermögens
Heptagon Fd-Kop.Gl.AI-CapEq. Reg. Shares CE Acc. EUR o.N.	IE00BH4GY991	ANT	7.500,00 EUR		218,1815	1.636.361,25	0,42
Lvx.FTSE It.PMI PIR 20(DR)U.E. Act. au Porteur Acc o.N.	FR0011758085	ANT	6.500,00 EUR		157,8800	1.026.220,00	0,26
Lyxor Index-L.Co.St.EO600(DR) Act. Nom.UCITS ETF Acc oN	LU0908500753	ANT	2.500,00 EUR		203,5000	508.750,00	0,13
M.U.L.-Lyxor MSCI Russi.UC.ETF Nam.-Ant. Acc.EUR o.N	LU1923627092	ANT	80.000,00 EUR		0,0000	0,00	0,00
Man Fds VI-Man GLG Hig. Yi.Opp. Reg.Acc.Shs I EUR o.N.	IE00BDTYYL24	ANT	106.000,00 EUR		127,6100	13.526.660,00	3,44
Man Funds-M.GLG Jap.CoreAI.Eq. Reg.Shs I H EUR o.N.	IE00B578XK25	ANT	17.000,00 EUR		243,9400	4.146.980,00	1,05
Man-GLG Gl. Invest Grade Opps Reg.Shs IF Hgd EUR Acc. oN	IE000FTP5ZV4	ANT	144.300,00 EUR		93,5600	13.500.708,00	3,43
MUL-LYXOR S&P 500 UCITS ETF Nam.-Ant. EUR Dis.oN	LU0496786574	ANT	260.000,00 EUR		38,3640	9.974.640,00	2,53
Neuberger-NB.US Large Cap Val. Reg.Shs I Unhdgd EUR Acc. oN	IE000OCOXIH6	ANT	210.000,00 EUR		9,1600	1.923.600,00	0,49
Odey Inv.Fds-Brook Eur.Foc.Fd. Reg.Shs I EUR Acc. o.N.	IE000YMX2574	ANT	15.000,00 EUR		162,8511	2.442.766,50	0,62
Pareto-Par.Nordic Corporate Bd Nam-Ant. H Acc.EUR o.N.	LU1311575093	ANT	100.000,00 EUR		116,7338	11.673.380,00	2,97
PIMCO Fds GIS - Income Fund Reg.Acc.Shs Inst.EUR Hed.o.N.	IE00B80G9288	ANT	500.000,00 EUR		13,8500	6.925.000,00	1,76
Plenum CAT Bd Dyn.Fd Inh.-Ant. P EUR Acc. oN	LI1115713706	ANT	36.000,00 EUR		99,1600	3.569.760,00	0,91
SEB PRIME Sol.SISSENER Corp.Bd Act. Nom. RF EUR Acc. oN	LU2262945038	ANT	510.000,00 EUR		10,9500	5.584.500,00	1,42
SPDR S+P US Comm. Ser.S.S.UETF Reg.Shs Acc.o.N.	IE00BFWFPX50	ANT	304.000,00 EUR		23,3550	7.099.920,00	1,80
SQUAD GALLO Europa Inhaber-Ant. SI	DE000A2P3PK6	ANT	22.000,00 EUR		156,9500	3.452.900,00	0,88
Storm Fund II-Storm Bond Fund Inhaber-Ant. ICL(EUR) o.N.	LU2058024444	ANT	45.000,00 EUR		122,2100	5.499.450,00	1,40
T. Rowe Pr-Euro Corp. Bond Act.Nom. I9 EUR Acc. oN	LU2573689044	ANT	290.000,00 EUR		10,1400	2.940.600,00	0,75
THEAM Quant-Cross Ass.Hi.Foc. Act.Nom. I EUR Acc. oN	LU2346213866	ANT	17.000,00 EUR		110,9100	1.885.470,00	0,48
Twelve Cat Bond Fund Reg. Shs SI1 EUR Acc. oN	IE00BKF1PS04	ANT	100.000,00 EUR		107,0000	10.700.000,00	2,72
W.M.Fds(I.)-W.Euro Hi.Yi.Bd Fd Reg.Shs E EUR Acc. oN	IE000EESGXZ0	ANT	200.000,00 EUR		10,1176	2.023.520,00	0,51
WMF(I)-W.Strat.Europ.Equity Fd Reg. Shares Class S EUR o.N.	IE00B6TYHG95	ANT	625.000,00 EUR		36,2014	22.625.875,00	5,75
Xtr.(IE)-S+P 500 Equal Weight Reg.Shs 1C USD o.N.	IE00BLNMYC90	ANT	55.000,00 EUR		70,4500	3.874.750,00	0,98
Xtrackers Euro Stoxx 50 Inhaber-Ant. 1D o.N.	LU0274211217	ANT	50.000,00 EUR		44,8500	2.242.500,00	0,57
Xtrackers S&P 500 Swap Inhaber-Ant. 1C USD o.N.	LU0490618542	ANT	233.500,00 EUR		72,9720	17.038.962,00	4,33
Smead Fds-Smead US Value UC.Fd Act.Nom. Y USD Acc. oN	LU2314635694	ANT	20.000,00 USD		283,3900	5.216.807,03	1,33
Geldmarktfonds							
AMUNDI EURO LIQUIDITY SRI Actions au Porteur IC o.N.	FR0010251660	ANT	122,00 EUR		232.448,6025	28.358.729,51	7,21
AXA IM Euro Liquidity Actions Port. (4 Déc.) o.N.	FR0000978371	ANT	150,00 EUR		44.582,2237	6.687.333,56	1,70
Summe Wertpapiervermögen			EUR			324.346.900,36	82,42
Derivate							
Aktienindex-Terminkontrakte							
S&P 500 E-Mini Index Future 16.06.23		STK	5,00 USD		4.137,7500	42.672,56	0,01
STXE 600 Future 16.06.23		STK	475,00 EUR		454,5000	329.652,37	0,08
STXE Small 200 Future 16.06.23		STK	250,00 EUR		312,1000	57.370,00	0,01
Zinsterminkontrakte							
Rentenindex-Terminkontrakte							
Ultra 10 Year T-Note Future 21.06.23		STK	120,00 USD		121,1406	401.250,86	0,10
Devisenterminkontrakte							
Devisenterminkontrakte (Kauf/Verkauf)							
EUR/GBP Future 16.06.23		GBP	30,00 EUR		0,8825	-14.723,45	0,00
EUR/USD Future 16.06.23		USD	622,00 EUR		1,0904	1.601.081,73	0,41

Die Notierung der Wertpapiere erfolgt in Stücken, bzw. Anteilen, bzw. in Währung in 1.000.
Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichtes.

Gattungsbezeichnung	ISIN	Notierung	Bestand	Kurs zum 31.03.2023	Kurswert in EUR	In % des Netto- Teilfonds- vermögens
Optionsrechte auf Devisenterminkontrakte						
Call EUR/USD 1,11 06.04.23		STK	-120,00 EUR	0,0001	-1.380,64	0,00
Call EUR/USD 1,115 06.04.23		STK	-60,00 EUR	0,0001	-345,16	0,00
Put EUR/USD 1,0306 04.23		STK	-120,00 EUR	0,0001	-690,32	0,00
Put EUR/USD 1,3506 04.23		STK	-60,00 EUR	0,0001	-345,16	0,00
Optionsrechte auf Aktienindizes						
Call Euro Stoxx 4300 19.05.23		STK	200,00 EUR	86,4000	172.800,00	0,04
Call Euro Stoxx 4325 16.06.23		STK	340,00 EUR	100,3000	341.020,00	0,09
Call Euro Stoxx 4425 21.04.23		STK	150,00 EUR	18,7000	28.050,00	0,01
Call Euro Stoxx 4500 19.05.23		STK	-200,00 EUR	17,5000	-35.000,00	-0,01
Call Nasdaq 13000 19.05.23		STK	7,00 USD	557,1100	358.946,11	0,09
Call Nasdaq 13750 19.05.23		STK	-7,00 USD	198,7500	-128.054,67	-0,03
Call S&P 4200 19.05.23		STK	45,00 USD	63,6000	263.426,76	0,07
Put Euro Stoxx 3800 19.05.23		STK	100,00 EUR	19,8000	19.800,00	0,01
Put Euro Stoxx 3925 16.06.23		STK	-200,00 EUR	51,4000	-102.800,00	-0,03
Put Euro Stoxx 4000 19.05.23		STK	-100,00 EUR	39,0000	-39.000,00	-0,01
Put Euro Stoxx 4100 21.04.23		STK	-150,00 EUR	17,3000	-25.950,00	-0,01
Put S&P 3600 21.04.23		STK	-25,00 USD	2,3500	-5.407,52	0,00
Put S&P 3700 19.05.23		STK	45,00 USD	17,9000	74.140,55	0,02
Put S&P 3900 19.05.23		STK	-45,00 USD	40,6500	-168.369,46	-0,04
Summe Derivate			EUR		3.168.144,56	0,81
Bankguthaben						
Bankkonten						
Bankkonto European Depositary Bank SA		CAD	171.537,43 EUR		116.664,35	0,03
Bankkonto European Depositary Bank SA		CHF	386.620,59 EUR		389.542,16	0,10
Bankkonto European Depositary Bank SA		GBP	232.044,32 EUR		264.076,84	0,07
Bankkonto European Depositary Bank SA		HKD	5.286.200,85 EUR		619.824,10	0,16
Bankkonto European Depositary Bank SA		JPY	5.981.435,00 EUR		41.366,65	0,01
Bankkonto European Depositary Bank SA		NOK	11.000.000,00 EUR		966.735,51	0,25
Bankkonto European Depositary Bank SA		SEK	4.385.005,26 EUR		389.224,68	0,10
Bankkonto European Depositary Bank SA		USD	3.116.050,09 EUR		2.868.102,62	0,73
Bankkonto Morgan Stanley wg. Futures/Options		CAD	268.614,15 EUR		182.687,22	0,05
Bankkonto Morgan Stanley wg. Futures/Options		CHF	892.845,32 EUR		899.592,26	0,23
Bankkonto Morgan Stanley wg. Futures/Options		EUR	5.046.962,64 EUR		5.046.962,64	1,28
Bankkonto Morgan Stanley wg. Futures/Options		GBP	986.639,84 EUR		1.122.840,38	0,29
Bankkonto Morgan Stanley wg. Futures/Options		HKD	3.690.520,29 EUR		432.725,41	0,11
Bankkonto Morgan Stanley wg. Futures/Options		SEK	6.594.839,33 EUR		585.375,41	0,15
Bankkonto Morgan Stanley wg. Futures/Options		USD	11.356.180,22 EUR		10.452.556,69	2,66
Forderungen aus Variation Margin		GBP	12.937,50 EUR		14.723,46	0,00
Callgeld(er)						
Callgeld Bayerische Landesbank (München)		EUR	20.000.000,00 EUR		20.000.000,00	5,08
Callgeld DZ BANK AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank (Frankfurt)		EUR	27.000.000,00 EUR		27.000.000,00	6,86
Summe Bankguthaben			EUR		71.393.000,38	18,14

Die Notierung der Wertpapiere erfolgt in Stücken, bzw. Anteilen, bzw. in Währung in 1.000.
Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichtes.

Gattungsbezeichnung	ISIN	Notierung	Bestand	Kurs zum 31.03.2023	Kurswert in EUR	In % des Netto-Teilfondsvermögens
Sonstige Vermögensgegenstände						
Zinsforderung(en) Callgeld(er)		EUR	18.655,56	EUR	18.655,56	0,00
Summe Sonstige Vermögensgegenstände				EUR	18.655,56	0,00
Bankverbindlichkeiten						
Bankverbindlichkeiten European Depository Bank SA		EUR	-2.579.070,51	EUR	-2.579.070,51	-0,66
Verbindlichkeiten aus Variation Margin		EUR	-387.022,37	EUR	-387.022,37	-0,10
Verbindlichkeiten aus Variation Margin		USD	-2.221.795,85	EUR	-2.045.005,15	-0,52
Summe Bankverbindlichkeiten				EUR	-5.011.098,03	-1,27
Zinsverbindlichkeiten						
Zinsverbindlichkeit(en) Callgeld(er)		EUR	-374,97	EUR	-374,97	0,00
Zinsverbindlichkeit Bankkonto European Depository Bank SA		EUR	-138,17	EUR	-138,17	0,00
Summe Zinsverbindlichkeiten				EUR	-513,14	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten¹⁾				EUR	-393.871,79	-0,10
Netto-Teilfondsvermögen				EUR	393.521.217,90	100,00^{*)}

*) Durch Rundungen bei der Berechnung können geringe Differenzen entstanden sein.

1) In den "Sonstigen Verbindlichkeiten" sind fremde Depotgebühren, Prüfungskosten, Risiko-Management-Gebühr, Taxe d'abonnement, Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung und Zentralverwaltungsvergütung enthalten.

Anteilswert des Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Conservative – I EUR	EUR	1.127,15
Anteilswert des Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Conservative – P EUR	EUR	54,95
Anteilswert des Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Conservative – R EUR	EUR	53,22
Anteilswert des Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Conservative – N EUR	EUR	45,21
Umlaufende Anteile des Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Conservative – I EUR	STK	164.264,079
Umlaufende Anteile des Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Conservative – P EUR	STK	2.963.488,818
Umlaufende Anteile des Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Conservative – R EUR	STK	663.441,119
Umlaufende Anteile des Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Conservative – N EUR	STK	226.291,250
Bestand der Wertpapiere am Netto-Teilfondsvermögen	%	82,42
Bestand der Derivate am Netto-Teilfondsvermögen	%	0,81

Die Notierung der Wertpapiere erfolgt in Stücken, bzw. Anteilen, bzw. in Währung in 1.000.
Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichtes.

Verpflichtungen aus Derivaten

Futures Kauf	Währung	Kontrakte	Kontraktgröße	Kurs Underlying	Dev.Kurs	Verpflichtungen aus Derivaten in EUR
EUR/USD Future 16.06.23	USD	622,00	125.000,00	1,0904	0,920429	78.029.097,06
STXE Small 200 Future 16.06.23	EUR	250,00	50,00	312,1000	1,000000	3.901.250,00
EUR/GBP Future 16.06.23	GBP	30,00	125.000,00	0,8825	1,138045	3.766.217,14
S&P 500 E-Mini Index Future 16.06.23	USD	5,00	50,00	4.137,7500	0,920429	952.126,19
Ultra 10 Year T-Note Future 21.06.23	USD	120,00	1.000,00	121,1406	0,920429	13.380.160,15
STXE 600 Future 16.06.23	EUR	475,00	50,00	454,5000	1,000000	10.794.375,00
Summe Futures Kauf						110.823.225,54

Optionen	Währung	Kontrakte	Kontraktgröße	Kurs Underlying	Dev.Kurs	Verpflichtungen aus Derivaten in EUR
Call EUR/USD 1,11 06.04.23	USD	-120,00	125.000,00	1,0904	0,920429	15.053.845,09
Call EUR/USD 1,115 06.04.23	USD	-60,00	125.000,00	1,0904	0,920429	7.526.922,55
Call Euro Stoxx 4500 19.05.23	EUR	-200,00	10,00	4.315,0500	1,000000	8.630.100,00
Call Nasdaq 13750 19.05.23	USD	-7,00	100,00	13.181,3505	0,920429	8.492.747,36
Put EUR/USD 1,03 06.04.23	USD	-120,00	125.000,00	1,0904	0,920429	15.053.845,09
Put EUR/USD 1,35 06.04.23	USD	-60,00	125.000,00	1,0904	0,920429	7.526.922,55
Put Euro Stoxx 3925 16.06.23	EUR	-200,00	10,00	4.315,0500	1,000000	8.630.100,00
Put Euro Stoxx 4000 19.05.23	EUR	-100,00	10,00	4.315,0500	1,000000	4.315.050,00
Put Euro Stoxx 4100 21.04.23	EUR	-150,00	10,00	4.315,0500	1,000000	6.472.575,00
Put S&P 3600 21.04.23	USD	-25,00	100,00	4.109,3100	0,920429	9.455.819,41
Put S&P 3900 19.05.23	USD	-45,00	100,00	4.109,3100	0,920429	17.020.474,94
Summe Optionen						108.178.401,99

Devisenkurse (in Mengennotiz)

			per	31.03.2023
Kanadischer Dollar	(CAD)	1,470350	= 1	EUR
Schweizer Franken	(CHF)	0,992500	= 1	EUR
Britisches Pfund	(GBP)	0,878700	= 1	EUR
Hongkong Dollar	(HKD)	8,528550	= 1	EUR
Japanischer Yen	(JPY)	144,595600	= 1	EUR
Norwegische Kronen	(NOK)	11,378500	= 1	EUR
Schwedische Kronen	(SEK)	11,266000	= 1	EUR
US-Dollar	(USD)	1,086450	= 1	EUR

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichtes.

Ertrags- und Aufwandsrechnung des Teilfonds

Assenagon I – Multi Asset Conservative im Zeitraum vom 1. Oktober 2022 bis 31. März 2023

	EUR
Erträge	
Erträge aus Investmentanteilen	263.311,59
Zinsen aus Geldanlagen	429.975,00
Erträge aus Bestandsprovisionen	4.594,97
Ordentlicher Ertragsausgleich	18.640,34
Erträge insgesamt	716.521,90
Aufwendungen	
Verwaltungsvergütung	-1.782.443,24
Zentralverwaltungsstellenvergütung	-75.620,70
Verwahrstellenvergütung	-84.965,10
Prüfungskosten	-17.616,60
Taxe d'abonnement	-41.304,73
Veröffentlichungskosten	-9.972,59
Register- und Transferstellenvergütung	-2.493,15
Zinsaufwendungen	-18.574,17
Sonstige Aufwendungen	-81.986,92
Ordentlicher Aufwandsausgleich	-72.987,91
Aufwendungen insgesamt	-2.187.965,11
Ordentlicher Nettoertrag	-1.471.443,21
Veräußerungsgeschäfte	
Realisierte Gewinne	14.405.354,23
Ertragsausgleich auf realisierte Gewinne	311.605,05
Realisierte Verluste	-9.730.961,71
Aufwandsausgleich auf realisierte Verluste	-163.229,84
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	4.822.767,73
Realisiertes Ergebnis des Berichtszeitraumes	3.351.324,52
Veränderung der nicht realisierten Gewinne und Verluste	
Veränderung der nicht realisierten Gewinne	12.794.074,43
Veränderung der nicht realisierten Verluste	-858.225,37
Nettoveränderung des nicht realisierten Ergebnisses des Berichtszeitraumes	11.935.849,06
Ergebnis des Berichtszeitraumes	15.287.173,58

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichtes.

Vermögensentwicklung des Teilfonds

Assenagon I – Multi Asset Conservative

	EUR
Netto-Teilfondsvermögen zum Beginn des Berichtszeitraumes	356.626.692,43
Ausschüttungen	-5.449.970,87
Mittelzuflüsse	37.391.030,97
Mittelabflüsse	-10.239.680,57
Mittelzufluss/-abfluss netto	27.151.350,40
Ertrags- und Aufwandsausgleich	-94.027,64
Ergebnis des Berichtszeitraumes inkl. Ertrags-/Aufwandsausgleich	15.287.173,58
Netto-Teilfondsvermögen zum Ende des Berichtszeitraumes	393.521.217,90

Entwicklung im Jahresvergleich

Assenagon I – Multi Asset Conservative – I EUR

Stichtag	Anteile	Währung	Vermögen	Anteilswert
31.03.2023	164.264,079	EUR	182.150.548,85	1.127,15
30.09.2022	150.539,645	EUR	162.666.924,69	1.080,56
30.09.2021	118.258,725	EUR	139.774.563,55	1.181,94

Assenagon I – Multi Asset Conservative – P EUR

Stichtag	Anteile	Währung	Vermögen	Anteilswert
31.03.2023	2.963.488,818	EUR	162.832.568,05	54,95
30.09.2022	2.724.957,809	EUR	148.038.423,87	54,33
30.09.2021	1.559.354,153	EUR	95.329.774,13	61,13

Assenagon I – Multi Asset Conservative – R EUR

Stichtag	Anteile	Währung	Vermögen	Anteilswert
31.03.2023	663.441,119	EUR	35.307.553,91	53,22
30.09.2022	696.304,711	EUR	36.527.521,00	52,46
30.09.2021	554.180,241	EUR	32.588.061,79	58,80

Assenagon I – Multi Asset Conservative – N EUR

Stichtag	Anteile	Währung	Vermögen	Anteilswert
31.03.2023	226.291,250	EUR	10.230.547,09	45,21
30.09.2022	209.898,199	EUR	9.393.822,87	44,75
30.09.2021	59.201,910	EUR	2.992.954,49	50,56

Der beige-fügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichtes.

Assenagon I – Multi Asset Balanced

Zusammensetzung des Netto-Teilfondsvermögens

Assenagon I – Multi Asset Balanced per 31. März 2023

Position	Betrag in EUR
Wertpapiervermögen	22.796.507,43
(Wertpapiereinstandskosten EUR 22.969.523,10)	
Derivate	328.856,75
Bankguthaben	5.337.262,17
Sonstige Vermögensgegenstände	7.580,65
Summe Aktiva	28.470.207,00
Bankverbindlichkeiten	-239.737,36
Zinsverbindlichkeiten	-1.380,46
Sonstige Verbindlichkeiten	-27.451,31
Summe Passiva	-268.569,13
Netto-Teilfondsvermögen	28.201.637,87

Währungsübersicht des Teilfonds

Assenagon I – Multi Asset Balanced

Währung	Kurswert in Mio. EUR	In % des Netto- Teilfondsvermögens
EUR	25,36	89,91
USD	1,84	6,54
GBP	0,26	0,91
CHF	0,20	0,71
SEK	0,19	0,68
HKD	0,15	0,53
CAD	0,13	0,47
NOK	0,07	0,25
Summe	28,20	100,00

Wertpapierkategorie-Übersicht des Teilfonds

Assenagon I – Multi Asset Balanced

Wertpapierkategorie	Kurswert in Mio. EUR	In % des Netto- Teilfondsvermögens
Wertpapier-Investmentanteile	21,20	75,16
Indexzertifikate	1,49	5,30
Aktien	0,11	0,37
Summe	22,80	80,83

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichtes.

Länderübersicht des Wertpapiervermögens des Teilfonds

Assenagon I – Multi Asset Balanced

Länder	Kurswert in Mio. EUR	In % des Netto- Teilfondsvermögens
Irland	11,04	39,15
Luxemburg	10,53	37,35
Bundesrepublik Deutschland	0,41	1,45
Liechtenstein	0,40	1,41
Frankreich	0,19	0,67
Kanada	0,12	0,43
Jersey	0,11	0,37
Summe	22,80	80,83

Vermögensaufstellung des Teilfonds

Assenagon I – Multi Asset Balanced zum 31. März 2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Notierung	Bestand	Kurs zum 31.03.2023	Kurswert in EUR	In % des Netto- Teilfonds- vermögens
Amtlich gehandelte Wertpapiere/Regulierter Markt						
Indexzertifikate						
Invesco Physical Markets PLC ETC 31.12.2100 Gold	IE00B579F325	STK	8.500,00 EUR	175,8700	1.494.895,00	5,30
Organisierter Markt						
Aktien						
Yellow Cake PLC Registered Shares LS-,01	JE00BF50RG45	STK	25.000,00 GBP	3,6920	105.041,54	0,37
Wertpapier-Investmentanteile						
Sprott Physical Uranium Trust Registered Units o.N.	CA85210A1049	ANT	11.500,00 CAD	15,4100	120.525,73	0,43
A.I.I.S.-All.Europ.Micro Cap Inhaber-Ant. IT (EUR)Acc. o.N.	LU0594339896	ANT	20,00 EUR	3.863,5900	77.271,80	0,27
Am.Fds-Amundi Fds Volatil.Euro Nam.-Ant. I EUR(C) oN	LU0272941112	ANT	50,00 EUR	1.348,2900	67.414,50	0,24
Amundi Fds-Europ. Equity Value Act. Nom. I2 Unh. EUR Acc. oN	LU1883315480	ANT	115,00 EUR	2.457,3000	282.589,50	1,00
Assenagon Alpha Volatility Nam.-Ant. I o.N.	LU0575255335	ANT	330,00 EUR	1.155,4200	381.288,60	1,35
AXA IM F.I.I.S.-US Sh.Dur.H.Y. Nam.-Ant. A(Cap.)EUR o.N.	LU0194345913	ANT	5.300,00 EUR	170,5900	904.127,00	3,21
BAKERSTEEL GBL - Electrum Fund Act. au Port. I EUR Acc. oN	LU1923360827	ANT	50,00 EUR	164,4600	8.223,00	0,03
BNP Paribas EO H. Yld S. Dur. Bd Act. Nom. I H EUR Cap o.N.	LU1022395633	ANT	8.400,00 EUR	117,3400	985.656,00	3,50
Brown Adv Btl Gdmn US Val Reg. Shs SIUH EUR Acc. oN	IE00BN940Q96	ANT	57.000,00 EUR	10,6900	609.330,00	2,16
Eleva UCITS-Eleva Abs. Ret. Eur. Nam.-Ant. S EUR acc. o.N.	LU1331974276	ANT	440,00 EUR	1.449,2600	637.674,40	2,26
F. Sent. Inv. Gl. U.-FSSA Jap. Equ. Reg. Shs VI EUR Acc. oN	IE00BFY84Q86	ANT	6.000,00 EUR	20,0030	120.018,00	0,43
Fed. He. IF-F.H.As. Ex-Jap. Equ. Fd Reg. Shs F Dist. EUR o.N.	IE00B831WC11	ANT	215.000,00 EUR	4,4727	961.630,50	3,41
Flossbach von Storch-Bd Oppor. Inhaber-Anteile IT o.N.	LU1481584016	ANT	12.000,00 EUR	115,1300	1.381.560,00	4,90
Fulcrum-Eq. Dispersion Fund Act. Nom. I EUR Acc. oN	LU2164655040	ANT	1.200,00 EUR	115,6351	138.762,12	0,49
Fundsmith SICAV-Equity Fund Nam.-Ant. I Dis.o.N.	LU0690374532	ANT	22.000,00 EUR	51,0655	1.123.441,00	3,98
Helium Fd-Helium Selection Act.-Nom. S Cap. EUR o.N.	LU1112771768	ANT	140,00 EUR	1.652,0460	231.286,44	0,82
HELIUM FDS-HELIUM INVEST Act. Nom. D Uhd EUR Acc. oN	LU1995646509	ANT	135,00 EUR	1.247,4220	168.401,97	0,60
Heptagon Fd-Kop. Gl. All-Cap Eq. Reg. Shs CE Acc. EUR o.N.	IE00BH4GY991	ANT	1.000,00 EUR	218,1815	218.181,50	0,77
Lyx. FTSE It. PMI PIR 20(DR)U.E. Act. au Porteur Acc o.N.	FR0011758085	ANT	1.200,00 EUR	157,8800	189.456,00	0,67
Lyxor Index-L.Co.St. EO 600(DR) Act. Nom. UCITS ETF Acc oN	LU0908500753	ANT	2.500,00 EUR	203,5000	508.750,00	1,80
M.U.L.-Lyxor MSCI Russi. UC.ETF Nam.-Ant. Acc. EUR o.N.	LU1923627092	ANT	6.000,00 EUR	0,0000	0,00	0,00
Man Fds VI-Man GLG Hig. Yi. Opp. Reg. Acc. Shs I EUR o.N.	IE00BDTYL24	ANT	7.800,00 EUR	127,6100	995.358,00	3,53

Die Notierung der Wertpapiere erfolgt in Stücken, bzw. Anteilen, bzw. in Währung in 1.000.
Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichtes.

Gattungsbezeichnung	ISIN	Notierung	Bestand		Kurs zum 31.03.2023	Kurswert in EUR	In % des Netto- Teilfonds- vermögens
Man Funds-M.GLG Jap.CoreAI.Eq.Reg.Shs I H EUR o.N.	IE00B578XK25	ANT	1.500,00	EUR	243,9400	365.910,00	1,30
Man-GLG Gl.Invest Grade Opps Reg. Shs IF Hgd EUR Acc. oN	IE000FTP5ZV4	ANT	16.100,00	EUR	93,5600	1.506.316,00	5,34
MUL-LYXOR S&P 500 UCITS ETF Nam.-Ant. EUR Dis.oN	LU0496786574	ANT	38.000,00	EUR	38,3640	1.457.832,00	5,17
Neuberger-NB.US Large Cap Val. Reg. Shs I Unhdgd EUR Acc. oN	IE000COXIH6	ANT	15.000,00	EUR	9,1600	137.400,00	0,49
Odey Inv.Fds-Brook Eur.Foc.Fd.Reg.Shs I EUR Acc. o.N.	IE000YMX2574	ANT	1.500,00	EUR	162,8511	244.276,65	0,87
Pareto-Par.Nordic Corporate Bd Nam.-Ant. H Acc.EUR o.N.	LU1311575093	ANT	4.700,00	EUR	116,7338	548.648,86	1,95
PIMCO Fds GIS - Income Fund Reg.Acc.Shs Inst.EUR Hed.o.N.	IE00B80G9288	ANT	22.000,00	EUR	13,8500	304.700,00	1,08
Plenum CAT Bd Dyn.Fd Inh.-Ant. P EUR Acc. oN	LI1115713706	ANT	4.000,00	EUR	99,1600	396.640,00	1,41
SEB PRIME Sol.SISSENER Corp.Bd Act. Nom. RF EUR Acc. oN	LU2262945038	ANT	18.500,00	EUR	10,9500	202.575,00	0,72
SPDR S+P US Comm.Ser.S.S.UETF Reg. Shs Acc.o.N.	IE00BFWFPX50	ANT	31.500,00	EUR	23,3550	735.682,50	2,61
SQUAD GALLO Europa Inhaber-Ant. SI	DE000A2P3PK6	ANT	2.600,00	EUR	156,9500	408.070,00	1,45
T. Rowe Pr-Euro Corp. Bond Act.Nom. I9 EUR Acc. oN	LU2573689044	ANT	21.000,00	EUR	10,1400	212.940,00	0,76
THEAM Quant-Cross Ass.Hi.Foc. Act.Nom. I EUR Acc. oN	LU2346213866	ANT	1.250,00	EUR	110,9100	138.637,50	0,49
Twelve Cat Bond Fund Reg. Shs SI1 EUR Acc. oN	IE00BKF1PS04	ANT	6.000,00	EUR	107,0000	642.000,00	2,28
W.M.Fds(I.)-W.Euro Hi.Yi.Bd FdReg.Shs E EUR Acc. oN	IE000EESGXZ0	ANT	20.000,00	EUR	10,1176	202.352,00	0,72
WMF(I)-W.Strat.Europ.Equity FdReg. Shs Class S EUR o.N.	IE00B6TYHG95	ANT	57.500,00	EUR	36,2014	2.081.580,50	7,38
Xtr.(IE)-S+P 500 Equal Weight Reg. Shs 1C USD o.N.	IE00BLNMYC90	ANT	6.000,00	EUR	70,4500	422.700,00	1,50
Xtrackers Euro Stoxx 50 Inhaber-Ant. 1D o.N.	LU0274211217	ANT	8.800,00	EUR	44,8500	394.680,00	1,40
Xtrackers S&P 500 Swap Inhaber-Ant. 1C USD o.N.	LU0490618542	ANT	3.100,00	EUR	72,9720	226.213,20	0,80
Smead Fds-SmeadUS Value UC.FdAct. Nom. Y USD Acc. oN	LU2314635694	ANT	1.750,00	USD	283,3900	456.470,62	1,62
Summe Wertpapiervermögen				EUR		22.796.507,43	80,83
Derivate							
Aktienindex-Terminkontrakte							
OMX 30 Index Future 21.04.23		STK	18,00	SEK	2.216,7500	14.690,21	0,05
S&P 500 E-Mini Index Future 16.06.23		STK	9,00	USD	4.137,7500	86.053,96	0,31
STXE 600 Future 16.06.23		STK	31,00	EUR	454,5000	20.243,00	0,07
STXE 600 Insurance Future 16.06.23		STK	11,00	EUR	313,0000	4.290,00	0,02
STXE Small 200 Future 16.06.23		STK	39,00	EUR	312,1000	11.720,08	0,04
Zinsterminkontrakte							
Rentenindex-Terminkontrakte							
Ultra 10 Year T-Note Future 21.06.23		STK	10,00	USD	121,1406	33.437,58	0,12
Devisen-Derivate							
Devisenterminkontrakte (Kauf/Verkauf)							
EUR/USD Future 16.06.23		USD	29,00	EUR	1,0904	69.302,55	0,25
Optionsrechte auf Aktienindices							
Call Euro Stoxx 4300 19.05.23		STK	23,00	EUR	86,4000	19.872,00	0,07
Call Euro Stoxx 4325 16.06.23		STK	40,00	EUR	100,3000	40.120,00	0,14
Call Euro Stoxx 4425 21.04.23		STK	15,00	EUR	18,7000	2.805,00	0,01
Call Euro Stoxx 4500 19.05.23		STK	-23,00	EUR	17,5000	-4.025,00	-0,01
Call Nasdaq 13000 19.05.23		STK	1,00	USD	557,1100	51.278,02	0,18
Call Nasdaq 13750 19.05.23		STK	-1,00	USD	198,7500	-18.293,52	-0,06
Call S&P 4200 19.05.23		STK	4,00	USD	63,6000	23.415,71	0,08

Die Notierung der Wertpapiere erfolgt in Stücken, bzw. Anteilen, bzw. in Währung in 1.000.
Der beigegefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichtes.

Gattungsbezeichnung	ISIN	Notierung	Bestand	Kurs zum 31.03.2023	Kurswert in EUR	In % des Netto- Teilfonds- vermögens
Put Euro Stoxx 3800 19.05.23		STK	11,00 EUR	19,8000	2.178,00	0,01
Put Euro Stoxx 3925 16.06.23		STK	-24,00 EUR	51,4000	-12.336,00	-0,04
Put Euro Stoxx 4000 19.05.23		STK	-11,00 EUR	39,0000	-4.290,00	-0,02
Put Euro Stoxx 4100 21.04.23		STK	-15,00 EUR	17,3000	-2.595,00	-0,01
Put S&P 3600 21.04.23		STK	-2,00 USD	2.3500	-432,60	0,00
Put S&P 3700 19.05.23		STK	4,00 USD	17,9000	6.590,27	0,02
Put S&P 3900 19.05.23		STK	-4,00 USD	40,6500	-14.966,17	-0,05
Optionsrechte auf Devisenterminkontrakte						
Call EUR/USD 1,11 06.04.23		STK	-9,00 EUR	0,0001	-103,55	0,00
Call EUR/USD 1,115 06.04.23		STK	-4,00 EUR	0,0001	-23,01	0,00
Put EUR/USD 1,03 06.04.23		STK	-9,00 EUR	0,0001	-51,77	0,00
Put EUR/USD 1,35 06.04.23		STK	-4,00 EUR	0,0001	-23,01	0,00
Summe Derivate			EUR		328.856,75	1,17
Bankguthaben						
Bankkonten						
Bankkonto European Depository Bank SA		CAD	19.009,89 EUR		12.928,82	0,05
Bankkonto European Depository Bank SA		CHF	169.521,11 EUR		170.802,13	0,61
Bankkonto European Depository Bank SA		EUR	1.839.521,87 EUR		1.839.521,87	6,52
Bankkonto European Depository Bank SA		GBP	16.379,32 EUR		18.640,40	0,07
Bankkonto European Depository Bank SA		HKD	499.616,11 EUR		58.581,60	0,21
Bankkonto European Depository Bank SA		NOK	800.000,00 EUR		70.308,04	0,25
Bankkonto European Depository Bank SA		SEK	99.782,73 EUR		8.856,98	0,03
Bankkonto European Depository Bank SA		USD	295.343,24 EUR		271.842,46	0,96
Bankkonto Morgan Stanley wg. Futures/Options		CHF	28.975,89 EUR		29.194,85	0,10
Bankkonto Morgan Stanley wg. Futures/Options		EUR	383.167,00 EUR		383.167,00	1,36
Bankkonto Morgan Stanley wg. Futures/Options		GBP	115.789,88 EUR		131.774,08	0,47
Bankkonto Morgan Stanley wg. Futures/Options		HKD	775.492,92 EUR		90.929,05	0,32
Bankkonto Morgan Stanley wg. Futures/Options		SEK	2.054.323,34 EUR		182.347,18	0,65
Bankkonto Morgan Stanley wg. Futures/Options		USD	1.160.728,10 EUR		1.068.367,71	3,79
Callgeld(er)						
Callgeld DZ BANK AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank (Frankfurt)		EUR	1.000.000,00 EUR		1.000.000,00	3,55
Summe Bankguthaben			EUR		5.337.262,17	18,93
Sonstige Vermögensgegenstände						
Gründungskosten		EUR	7.502,87 EUR		7.502,87	0,03
Zinsforderung(en) Callgeld(er)		EUR	77,78 EUR		77,78	0,00
Summe Sonstige Vermögensgegenstände			EUR		7.580,65	0,03
Bankverbindlichkeiten						
Verbindlichkeiten aus Variation Margin		EUR	-36.253,08 EUR		-36.253,08	-0,13
Verbindlichkeiten aus Variation Margin		SEK	-165.499,92 EUR		-14.690,21	-0,05
Verbindlichkeiten aus Variation Margin		USD	-205.115,33 EUR		-188.794,07	-0,67
Summe Bankverbindlichkeiten			EUR		-239.737,36	-0,85

Die Notierung der Wertpapiere erfolgt in Stücken, bzw. Anteilen, bzw. in Währung in 1.000.
Der beigegefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichtes.

Gattungsbezeichnung	ISIN	Notierung	Bestand	Kurs zum 31.03.2023	Kurswert in EUR	In % des Netto- Teilfonds- vermögens
Zinsverbindlichkeiten						
Zinsverbindlichkeit(en) Callgeld(er)		EUR	-1.352,35	EUR	-1.352,35	0,00
Zinsverbindlichkeit Bankkonto European Depository Bank SA		EUR	-28,11	EUR	-28,11	0,00
Summe Zinsverbindlichkeiten				EUR	-1.380,46	0,00
Summe Sonstige Verbindlichkeiten ¹⁾				EUR	-27.451,31	-0,10
Netto-Teilfondsvermögen				EUR	28.201.637,87	100,00 ^{*)}

*) Durch Rundungen bei der Berechnung können geringe Differenzen entstanden sein.

1) In den "Sonstigen Verbindlichkeiten" sind fremde Depotgebühren, Prüfungskosten, Risiko-Management-Gebühr, sonstige Spesen, Taxe d'abonnement, Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung und Zentralverwaltungsvergütung enthalten.

Anteilwert des Teilfonds Assenagon I Multi Asset Balanced - I EUR	EUR	923,89
Anteilwert des Teilfonds Assenagon I Multi Asset Balanced - P EUR	EUR	44,48
Anteilwert des Teilfonds Assenagon I Multi Asset Balanced - R EUR	EUR	44,74
Anteilwert des Teilfonds Assenagon I Multi Asset Balanced - ZZ EUR	EUR	92.866,23
Umlaufende Anteile des Teilfonds Assenagon I Multi Asset Balanced - I EUR	STK	50,00
Umlaufende Anteile des Teilfonds Assenagon I Multi Asset Balanced - P EUR	STK	1.995,00
Umlaufende Anteile des Teilfonds Assenagon I Multi Asset Balanced - R EUR	STK	4.623,00
Umlaufende Anteile des Teilfonds Assenagon I Multi Asset Balanced - ZZ EUR	STK	300,00
Bestand der Wertpapiere am Netto-Teilfondsvermögen	%	80,83
Bestand der Derivate am Netto-Teilfondsvermögen	%	1,17

Verpflichtungen aus Derivaten

Futures Kauf	Währung	Kontrakte	Kontraktgröße	Kurs Underlying	Dev.Kurs	Verpflichtungen aus Derivaten in EUR
STXE 600 Future 16.06.23	EUR	31,00	50,00	454,5000	1,000000	704.475,00
Ultra 10 Year T-Note Future 21.06.23	USD	10,00	1.000,00	121,1406	0,920429	1.115.013,35
STXE 600 Insurance Future 16.06.23	EUR	11,00	50,00	313,0000	1,000000	172.150,00
S&P 500 E-Mini Index Future 16.06.23	USD	9,00	50,00	4.137,7500	0,920429	1.713.827,14
STXE Small 200 Future 16.06.23	EUR	39,00	50,00	312,1000	1,000000	608.595,00
OMX 30 Index Future 21.04.23	SEK	18,00	100,00	2.216,7500	0,088763	354.176,28
EUR/USD Future 16.06.23	USD	29,00	125.000,00	1,0904	0,920429	3.638.012,56
Summe Futures Kauf						8.306.249,33

Die Notierung der Wertpapiere erfolgt in Stücken, bzw. Anteilen, bzw. in Währung in 1.000.
Der beigegefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichtes.

Optionen	Währung	Kontrakte	Kontraktgröße	Kurs Underlying	Dev.Kurs	Verpflichtungen aus Derivaten in EUR
Call EUR/USD 1,11 06.04.23	USD	-9,00	125.000,00	1,0904	0,920429	1.129.038,38
Call EUR/USD 1,115 06.04.23	USD	-4,00	125.000,00	1,0904	0,920429	501.794,84
Call Euro Stoxx 4500 19.05.23	EUR	-23,00	10,00	4.315,0500	1,000000	992.461,50
Call Nasdaq 13750 19.05.23	USD	-1,00	100,00	13.181,3505	0,920429	1.213.249,62
Put EUR/USD 1,03 06.04.23	USD	-9,00	125.000,00	1,0904	0,920429	1.129.038,38
Put EUR/USD 1,35 06.04.23	USD	-4,00	125.000,00	1,0904	0,920429	501.794,84
Put Euro Stoxx 3925 16.06.23	EUR	-24,00	10,00	4.315,0500	1,000000	1.035.612,00
Put Euro Stoxx 4000 19.05.23	EUR	-11,00	10,00	4.315,0500	1,000000	474.655,50
Put Euro Stoxx 4100 21.04.23	EUR	-15,00	10,00	4.315,0500	1,000000	647.257,50
Put S&P 3600 21.04.23	USD	-2,00	100,00	4.109,3100	0,920429	756.465,55
Put S&P 3900 19.05.23	USD	-4,00	100,00	4.109,3100	0,920429	1.512.931,11
Summe Optionen						9.894.299,22

Devisenkurse (in Mengennotiz)

			per	31.03.2023
Kanadischer Dollar	(CAD)	1,470350	= 1	EUR
Schweizer Franken	(CHF)	0,992500	= 1	EUR
Britisches Pfund	(GBP)	0,878700	= 1	EUR
Hongkong Dollar	(HKD)	8,528550	= 1	EUR
Norwegische Kronen	(NOK)	11,378500	= 1	EUR
Schwedische Kronen	(SEK)	11,266000	= 1	EUR
US-Dollar	(USD)	1,086450	= 1	EUR

Ertrags- und Aufwandsrechnung des Teilfonds

Assenagon I – Multi Asset Balanced im Zeitraum vom 1. Oktober 2022 bis 31. März 2023

	EUR
Erträge	
Erträge aus Investmentanteilen	42.535,20
Zinsen aus Geldanlagen	41.671,43
Erträge aus Bestandsprovisionen	409,30
Erträge insgesamt	84.615,93
Aufwendungen	
Verwaltungsvergütung	-57.084,23
Zentralverwaltungsstellenvergütung	-10.027,03
Verwahrstellenvergütung	-7.908,01
Prüfungskosten	1.691,77
Taxe d'abonnement	-1.205,22
Veröffentlichungskosten	-3.490,41
Register- und Transferstellenvergütung	-2.493,16
Gründungskosten	-1.012,99
Zinsaufwendungen	-3.071,44
Sonstige Aufwendungen	-41.398,99
Aufwendungen insgesamt	-125.999,71
Ordentlicher Nettoertrag	-41.383,78
Veräußerungsgeschäfte	
Realisierte Gewinne	1.182.422,89
Realisierte Verluste	-1.282.497,29
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	-100.074,40
Realisiertes Ergebnis des Berichtszeitraumes	-141.458,18
Veränderung der nicht realisierten Gewinne und Verluste	
Veränderung der nicht realisierten Gewinne	2.285.862,71
Veränderung der nicht realisierten Verluste	-151.876,25
Nettoveränderung des nicht realisierten Ergebnisses des Berichtszeitraumes	2.133.986,46
Ergebnis des Berichtszeitraumes	1.992.528,28

Der beigegefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichtes.

Vermögensentwicklung des Teilfonds

Assenagon I – Multi Asset Balanced

	EUR
Netto-Teilfondsvermögen zum Beginn des Berichtszeitraumes	35.527.700,58
Ausschüttungen	-6.064,41
Mittelzuflüsse	114.565,38
Mittelabflüsse	-9.427.091,96
Mittelzufluss/-abfluss netto	-9.312.526,58
Ergebnis des Berichtszeitraumes inkl. Ertrags-/Aufwandsausgleich	1.992.528,28
Netto-Teilfondsvermögen zum Ende des Berichtszeitraumes	28.201.637,87

Entwicklung im Jahresvergleich

Assenagon I – Multi Asset Balanced – I EUR

Stichtag	Anteile	Währung	Vermögen	Anteilswert
31.03.2023	50,000	EUR	46.194,72	923,89
30.09.2022	50,000	EUR	43.840,57	876,81
08.12.2021 *)	50,000	EUR	50.000,00	1.000,00

Assenagon I – Multi Asset Balanced – P EUR

Stichtag	Anteile	Währung	Vermögen	Anteilswert
31.03.2023	1.995,000	EUR	88.735,58	44,48
30.09.2022	2.580,000	EUR	112.666,74	43,67
08.12.2021 *)	1.000,000	EUR	50.000,00	50,00

Assenagon I – Multi Asset Balanced – R EUR

Stichtag	Anteile	Währung	Vermögen	Anteilswert
31.03.2023	4.623,000	EUR	206.839,63	44,74
30.09.2022	4.131,000	EUR	181.038,25	43,82
08.12.2021 *)	1.000,000	EUR	50.000,00	50,00

Assenagon I – Multi Asset Balanced – ZZ EUR

Stichtag	Anteile	Währung	Vermögen	Anteilswert
31.03.2023	300,000	EUR	27.859.867,94	92.866,23
30.09.2022	400,000	EUR	35.190.155,02	87.975,39
08.12.2021 *)	400,000	EUR	40.000.000,00	100.000,00

*) Datum der Erstausgabe.

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichtes.

Zusammenfassung des Assenagon I

Zusammensetzung des Netto-Fondsvermögens

Position	Betrag in EUR
Wertpapiervermögen	347.143.407,79
Derivate	3.497.001,31
Bankguthaben	76.730.262,55
Sonstige Vermögensgegenstände	26.236,21
Summe Aktiva	427.396.907,86
Bankverbindlichkeiten	-5.250.835,39
Zinsverbindlichkeiten	-1.893,60
Sonstige Verbindlichkeiten	-421.323,10
Summe Passiva	-5.674.052,09
Netto-Fondsvermögen	421.722.855,77

Vermögensentwicklung des Netto-Fondsvermögens

	EUR
Netto-Fondsvermögen zum Beginn des Berichtszeitraumes	392.154.393,01
Ausschüttungen	-5.456.035,28
Mittelzuflüsse	37.505.596,35
Mittelabflüsse	-19.666.772,53
Mittelzufluss/-abfluss netto	17.838.823,82
Ertrags- und Aufwandsausgleich	-94.027,64
Ergebnis des Berichtszeitraumes inkl. Ertrags-/Aufwandsausgleich	17.279.701,86
Netto-Fondsvermögen zum Ende des Berichtszeitraumes	421.722.855,77

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichtes.

Ertrags- und Aufwandsrechnung des Fonds

	EUR
Erträge	
Erträge aus Investmentanteilen	305.846,79
Zinsen aus Geldanlagen	471.646,43
Erträge aus Bestandsprovisionen	5.004,27
Ordentlicher Ertragsausgleich	18.640,34
Erträge insgesamt	801.137,83
Aufwendungen	
Verwaltungsvergütung	-1.839.527,47
Zentralverwaltungsstellenvergütung	-85.647,73
Verwahrstellenvergütung	-92.873,11
Prüfungskosten	-15.924,83
Taxe d'abonnement	-42.509,95
Veröffentlichungskosten	-13.463,00
Register- und Transferstellenvergütung	-4.986,31
Gründungskosten	-1.012,99
Zinsaufwendungen	-21.645,61
Sonstige Aufwendungen	-123.385,91
Ordentlicher Aufwandsausgleich	-72.987,91
Aufwendungen insgesamt	-2.313.964,82
Ordentlicher Nettoertrag	-1.512.826,99
Veräußerungsgeschäfte	
Realisierte Gewinne	15.587.777,12
Ertragsausgleich auf realisierte Gewinne	311.605,05
Realisierte Verluste	-11.013.459,00
Aufwandsausgleich auf realisierte Verluste	-163.229,84
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	4.722.693,33
Realisiertes Ergebnis des Berichtszeitraumes	3.209.866,34
Veränderung der nicht realisierten Gewinne und Verluste	
Veränderung der nicht realisierten Gewinne	15.079.937,14
Veränderung der nicht realisierten Verluste	-1.010.101,62
Nettoveränderung des nicht realisierten Ergebnisses des Berichtszeitraumes	14.069.835,52
Ergebnis des Berichtszeitraumes	17.279.701,86

Der beigegefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichtes.

Anhang zum ungeprüften Halbjahresbericht

Allgemein

Der Assenagon I (der "Fonds") ist am 16. November 2015 als ein "Fonds Commun de Placement à Compartiments Multiples" gemäß Teil I des geänderten luxemburgischen Gesetzes vom 17. Dezember 2010 gegründet worden und erfüllt die Voraussetzungen eines Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW).

Der Fonds ist als Umbrella aufgelegt worden und die Verwaltungsgesellschaft beschließt, ob einer oder mehrere Teilfonds aufgelegt werden.

Gegenwärtig sind zwei Teilfonds im Fonds Assenagon I aufgelegt:

- Assenagon I - Multi Asset Conservative
- Assenagon I - Multi Asset Balanced

Anteile der Anteilklassen I und P des Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Conservative werden seit dem 16. November 2015 zum Kauf angeboten, die Anteilklasse R seit dem 13. Dezember 2017 und die Anteilklasse N seit dem 20. April 2021.

Anteile der Anteilklassen I, P, R und ZZ des Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Balanced werden seit dem 8. Dezember 2021 zum Kauf angeboten.

Der Fonds und seine Teilfonds bilanzieren in Euro. Der Halbjahresbericht wurde auf der Basis der letzten Nettoinventarwertberechnung zum 31. März 2023 aufgestellt.

Der vorliegende Bericht wurde gemäß den in Luxemburg geltenden Vorschriften (LUX-GAAP) unter der Annahme der Unternehmensfortführung erstellt.

Bewertungs- und Bilanzierungsgrundsätze

Die Erstellung des Jahresabschlusses erfolgt in Übereinstimmung mit den luxemburgischen Vorschriften in Bezug auf Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW).

1. Das jeweilige Netto-Teilfondsvermögen wird nachfolgenden Grundsätzen berechnet:

- a) Vermögenswerte, die an einer Börse amtlich notiert sind, werden zum letzten verfügbaren Kurs bewertet. Wenn ein Vermögenswert an mehreren Börsen notiert ist, ist der letzte verfügbare Kurs an jener Börse maßgebend, die der Hauptmarkt für diesen Vermögenswert ist.
- b) Vermögenswerte, die nicht an einer Börse notiert sind, die aber an einem anderen geregelten, anerkannten, für das Publikum offenen und ordnungsgemäß funktionierenden Markt gehandelt werden, werden zu dem Kurs bewertet, der nicht geringer als der Geldkurs und nicht höher als der Briefkurs zur Zeit der Bewertung sein darf und den die Verwaltungsgesellschaft für den bestmöglichen Kurs hält, zu dem die Vermögenswerte verkauft werden können.
- c) Nicht börsennotierte Derivate werden auf einer von der Verwaltungsgesellschaft festzulegenden und überprüfbaren Bewertung auf Tagesbasis bewertet. Die für die Preisfeststellung der Derivate bestimmten Kriterien erfolgen in üblicher, vom Wirtschaftsprüfer nachvollziehbaren, Weise.
- d) Falls die unter Buchstaben a) und b) genannten Kurse nicht marktgerecht sind oder sofern ein Vermögenswert nicht an einer Börse oder auf einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt wird oder sofern für Vermögenswerte, welche an einer Börse oder auf einem anderen Markt wie vorerwähnt notiert oder gehandelt werden, die Kurse entsprechend den Regelungen in a) oder b) den tatsächlichen Marktwert der entsprechenden Vermögenswerte nicht angemessen widerspiegeln, werden diese Vermögenswerte ebenso wie alle anderen Vermögenswerte zum jeweiligen Verkehrswert bewertet, wie ihn die Verwaltungsgesellschaft nach Treu und Glauben und allgemein anerkannten, von Wirtschaftsprüfern nachprüfbar, Bewertungsregeln festlegt.
- e) Die auf Vermögenswerte entfallenden anteiligen Zinsen werden miteinbezogen, soweit sie sich nicht im Kurswert ausdrücken.
- f) Der Liquidationswert von Forwards oder Optionen, die nicht an Börsen oder anderen organisierten Märkten gehandelt werden, wird gemäß den Richtlinien des Verwaltungsrates auf einer konsistent für alle verschiedenen Arten von Verträgen angewandten Grundlage festgestellt. Der Liquidationswert von Futures oder Optionen, welche an Börsen oder anderen organisierten Märkten gehandelt werden, wird auf der Grundlage der letzten verfügbaren Abwicklungspreise solcher Verträge an den Börsen oder organisierten Märkten, auf welchen diese Futures oder Optionen vom Teilfonds gehandelt werden, berechnet; sofern ein Future, ein Forward oder eine Option an einem Tag, für welchen der Nettoinventarwert bestimmt wird, nicht liquidiert werden kann, wird die Bewertungsgrundlage für einen solchen Vertrag vom Verwaltungsrat in angemessener und vernünftiger Weise bestimmt.
- g) Swaps werden zum Barwert (Present Value) bewertet.

- h) Flüssige Mittel werden zu deren Nennwert zuzüglich anteiliger Zinsen bewertet. Festgelder können zum jeweiligen Renditekurs bewertet werden, vorausgesetzt, ein entsprechender Vertrag zwischen dem Finanzinstitut, welches die Festgelder verwahrt, und der Verwaltungsgesellschaft sieht vor, dass diese Festgelder zu jeder Zeit kündbar sind und dass im Falle einer Kündigung ihr Realisierungswert diesem Renditekurs entspricht.
 - i) Zielfondsanteile werden zum letzten festgestellten und erhältlichen Nettoinventarwert bewertet. Falls für Investmentanteile die Rücknahme ausgesetzt ist oder keine Rücknahmepreise festgelegt werden, werden die Anteile ebenso wie alle anderen Vermögenswerte zum jeweiligen Verkehrswert bewertet, wie ihn die Verwaltungsgesellschaft nach Treu und Glauben auf der Grundlage des wahrscheinlich errechenbaren Verkehrswertes festlegt.
 - j) Alle nicht auf die jeweilige Teilfondswährung lautenden Vermögenswerte werden zum letzten verfügbaren Devisenkurs in die betreffende Teilfondswährung umgerechnet. Gewinne oder Verluste aus Devisentransaktionen werden hinzugerechnet oder abgesetzt.
 - k) Sämtliche sonstigen Wertpapiere oder sonstigen Vermögenswerte werden zu ihrem angemessenen Verkehrswert bewertet, wie dieser nach Treu und Glauben von der Verwaltungsgesellschaft und nach einem von ihr festgelegten Verfahren bestimmt wird.
2. Die Verwaltungsgesellschaft kann nach eigenem Ermessen andere Bewertungsmethoden zulassen, wenn sie dieses im Interesse einer angemesseneren Bewertung eines Vermögenswertes des Teilfonds für angebracht hält.
 3. Wenn die Verwaltungsgesellschaft der Ansicht ist, dass der ermittelte Nettoinventarwert an einem bestimmten Bewertungstag den tatsächlichen Wert der Anteile des Teilfonds nicht wiedergibt, oder wenn es seit der Ermittlung des Nettoinventarwertes beträchtliche Bewegungen an den betreffenden Börsen und/oder Märkten gegeben hat, kann die Verwaltungsgesellschaft beschließen, den Nettoinventarwert noch am selben Tag zu aktualisieren. Unter diesen Umständen werden alle für diesen Bewertungstag eingegangenen Anträge auf Zeichnung und Rücknahme auf der Grundlage des Nettoinventarwertes eingelöst, der unter Berücksichtigung des Grundsatzes von Treu und Glauben aktualisiert worden ist.
 4. Das jeweilige Netto-Teilfondsvermögen wird gegebenenfalls um Ausschüttungen reduziert, die an die Anleger des Teilfonds gezahlt werden.
 5. Für die jeweiligen Anteilklassen erfolgt die daraus resultierende Anteilwertberechnung nach den vorstehend aufgeführten Kriterien für jede Anteilklasse getrennt. Die Zusammenstellung und Zuordnung der Aktiva erfolgt jedoch immer für den gesamten Teilfonds.
 6. Auf die ordentlichen und außerordentlichen Erträge kann ein Ertragsausgleich gerechnet werden.
 7. Die Aufstellungen „Zusammensetzung des Netto-Fondsvermögens“, „Vermögensentwicklung des Netto-Fondsvermögens“ und „Ertrags- und Aufwandsrechnung des Fonds“ im Abschnitt „Zusammenfassung des Assenagon I“ auf den Seiten 19 und 20 dieses Berichtes, entsprechen der Summe der beiden Teilfonds des Umbrella-Fonds Assenagon I.

Erträge

Dividenden werden an dem Datum, an dem die betreffenden Wertpapiere erstmals "Ex-Dividende" notiert werden, als Ertrag verbucht. Zinserträge laufen täglich auf.

Realisierte Gewinne oder Verluste aus dem Verkauf von Wertpapieren

Realisierte Gewinne oder Verluste aus dem Verkauf von Wertpapieren werden nach der Durchschnittskostenmethode ermittelt.

Kosten

Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Conservative

Für die Anteilklasse I

Die Verwaltungsgesellschaft entnimmt dem Teilfonds ein Entgelt von 0,7 % p. a. Diese Vergütung wird täglich berechnet und abgegrenzt und am Monatsultimo auf Basis des durchschnittlichen monatlichen Netto-Teilfondsvermögen ausbezahlt. Die Vergütung versteht sich zuzüglich einer etwaigen Mehrwertsteuer.

Für die Anteilklasse P

Die Verwaltungsgesellschaft entnimmt dem Teilfonds ein Entgelt von 1,1 % p. a. Diese Vergütung wird täglich berechnet und abgegrenzt und am Monatsultimo auf Basis des durchschnittlichen monatlichen Netto-Teilfondsvermögen ausbezahlt. Die Vergütung versteht sich zuzüglich einer etwaigen Mehrwertsteuer.

Für die Anteilsklasse N

Die Verwaltungsgesellschaft entnimmt dem Teilfonds ein Entgelt von 1,4 % p. a. Diese Vergütung wird täglich berechnet und abgegrenzt und am Monatsultimo auf Basis des durchschnittlichen monatlichen Netto-Teilfondsvermögen ausbezahlt. Die Vergütung versteht sich zuzüglich einer etwaigen Mehrwertsteuer.

Für die Anteilsklasse R

Die Verwaltungsgesellschaft entnimmt dem Teilfonds ein Entgelt von 0,7 % p. a. Diese Vergütung wird täglich berechnet und abgegrenzt und am Monatsultimo auf Basis des durchschnittlichen monatlichen Netto-Teilfondsvermögen ausbezahlt. Die Vergütung versteht sich zuzüglich einer etwaigen Mehrwertsteuer.

Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Balanced

Für die Anteilsklasse I

Die Verwaltungsgesellschaft entnimmt dem Teilfonds ein Entgelt von 0,75 % p. a. Diese Vergütung wird täglich berechnet und abgegrenzt und am Monatsultimo auf Basis des durchschnittlichen monatlichen Netto-Teilfondsvermögen ausbezahlt. Die Vergütung versteht sich zuzüglich einer etwaigen Mehrwertsteuer.

Für die Anteilsklasse P

Die Verwaltungsgesellschaft entnimmt dem Teilfonds ein Entgelt von 1,2 % p. a. Diese Vergütung wird täglich berechnet und abgegrenzt und am Monatsultimo auf Basis des durchschnittlichen monatlichen Netto-Teilfondsvermögen ausbezahlt. Die Vergütung versteht sich zuzüglich einer etwaigen Mehrwertsteuer.

Für die Anteilsklasse R

Die Verwaltungsgesellschaft entnimmt dem Teilfonds ein Entgelt von 0,75 % p. a. Diese Vergütung wird täglich berechnet und abgegrenzt und am Monatsultimo auf Basis des durchschnittlichen monatlichen Netto-Teilfondsvermögen ausbezahlt. Die Vergütung versteht sich zuzüglich einer etwaigen Mehrwertsteuer.

Für die Anteilsklasse ZZ

Die Verwaltungsgesellschaft entnimmt dem Teilfonds ein Entgelt von 0,35 % p. a. Diese Vergütung wird täglich berechnet und abgegrenzt und am Monatsultimo auf Basis des durchschnittlichen monatlichen Netto-Teilfondsvermögen ausbezahlt. Die Vergütung versteht sich zuzüglich einer etwaigen Mehrwertsteuer.

Die Verwahrstelle und die Zahlstelle in Luxemburg sind berechtigt ein Entgelt von bis zu 0,04 % p. a., mindestens jedoch EUR 10.000 p. a. zu erhalten. Zusätzliche fixe und transaktionsabhängige Gebühren werden von der Verwahrstelle entsprechend der erbrachten Dienstleistungen berechnet. Die Vergütung wird täglich abgegrenzt und am Ende des Kalenderquartals auf Basis des durchschnittlichen Teilfondsvermögens berechnet und ausbezahlt. Die Vergütung versteht sich zuzüglich einer etwaigen Mehrwertsteuer.

Die Zentralverwaltung ist berechtigt ein Entgelt von bis zu 0,04 % p. a., mindestens jedoch EUR 20.000 p. a. zu erhalten. Die weiteren Gebühren bestimmen sich nach dem gesonderten Leistungsverzeichnis der Zentralverwaltung. Die Vergütung wird täglich abgegrenzt und am Ende des Kalenderquartals auf Basis des durchschnittlichen Teilfondsvermögens berechnet und ausbezahlt. Die Vergütung versteht sich zuzüglich einer etwaigen Mehrwertsteuer.

Die Kosten für die Gründung des Teilfonds und die Erstaussgabe von Anteilen können über einen Zeitraum von höchstens fünf Jahren abgeschrieben werden.

Zudem können dem Teilfonds sonstige Kosten gemäß Art. 13 des Verwaltungsreglements belastet werden.

Hinweis zur Performance-Fee im Berichtszeitraum

Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Conservative

Die Verwaltungsgesellschaft erhält aus dem Netto-Teilfondsvermögen eine Performance Fee. Diese erfolgsabhängige Vergütung beträgt für die Anteilklassen I, P, R und N des Teilfonds 10% der Wertentwicklung, die über 2,5% („Hurdle Rate“) p.a. hinausgeht.

Diese Mehr- bzw. Minderperformance wird täglich ermittelt und ein möglicher Anspruch in der Fondspreisermittlung berücksichtigt. Ein positiver Anspruch wird in der Regel nach Abschluss eines Geschäftsjahres ausgezahlt. Eine High-Water-Mark gewährleistet, dass eine wiederkehrende Mehrperformance bei schwankenden Preisen der Verwaltungsgesellschaft nur einmalig vergütet wird. Für die abgelaufene Berichtsperiode sind keine Performance Fees angefallen.

Assenagon I	Anteil-Klasse	Performance Fee in EUR	Performance Fee In % des durchschnittl. Nettovermögens der Anteilsklasse
Assenagon I – Multi Asset Conservative	I EUR	0,00	0,00 %
Assenagon I – Multi Asset Conservative	P EUR	0,00	0,00 %
Assenagon I – Multi Asset Conservative	R EUR	0,00	0,00 %
Assenagon I – Multi Asset Conservative	N EUR	0,00	0,00 %

Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Balanced

Die Verwaltungsgesellschaft erhält aus dem Netto-Teilfondsvermögen eine Performance Fee. Diese erfolgsabhängige Vergütung beträgt für den die Klassen I, P und R des Teilfonds 10% der Wertentwicklung, die über 3,0% („Hurdle Rate“) p.a. hinausgeht. Für die Anteilklasse ZZ des Teilfonds beträgt diese 20% der Wertentwicklung bei einer Hurdle Rate von 0,0%.

Diese Mehr- bzw. Minderperformance wird täglich ermittelt und ein möglicher Anspruch in der Fondspreisermittlung berücksichtigt. Ein positiver Anspruch wird in der Regel nach Abschluss eines Geschäftsjahres ausgezahlt. Eine High-Water-Mark gewährleistet, dass eine wiederkehrende Mehrperformance bei schwankenden Preisen der Verwaltungsgesellschaft nur einmalig vergütet wird. Für die abgelaufene Berichtsperiode sind keine Performance Fees angefallen.

Assenagon I	Anteil-Klasse	Performance Fee in EUR	Performance Fee In % des durchschnittl. Nettovermögens der Anteilsklasse
Assenagon I – Multi Asset Balanced	I EUR	0,00	0,00 %
Assenagon I – Multi Asset Balanced	P EUR	0,00	0,00 %
Assenagon I – Multi Asset Balanced	R EUR	0,00	0,00 %
Assenagon I – Multi Asset Balanced	ZZ EUR	0,00	0,00 %

Weitere Informationen zur Performance Fee-Berechnung befinden sich im Verkaufsprospekt.

Ausweis der Kontrahenten

Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Conservative und Assenagon I – Multi Asset Balanced

Beide Teilfonds haben im Berichtszeitraum Geschäfte über Derivate mit den folgenden Kontrahenten getätigt:

- European Depositary Bank S.A.

Aufstellung über die Entwicklung des Wertpapierbestandes

Auf Anfrage ist am eingetragenen Sitz der Verwaltungsgesellschaft sowie bei der Zahl- und Informationsstelle eine kostenfreie Aufstellung mit detaillierten Angaben über sämtliche während des Berichtszeitraums getätigten Käufe und Verkäufe erhältlich.

Ertragsverwendung

Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Conservative

Die Anteilsklasse I des Teilfonds ist thesaurierend. Die Anteilsklasse P, N und R des Teilfonds sind ausschüttend. Im Berichtszeitraum fanden folgende Ausschüttungen statt:

Teilfonds	Anteilsklasse	Ex-Tag	Ausschüttung je Anteil	
Assenagon I – Multi Asset Conservative	P EUR	17.11.2022	EUR	1,53
Assenagon I – Multi Asset Conservative	N EUR	17.11.2022	EUR	1,26
Assenagon I – Multi Asset Conservative	R EUR	17.11.2022	EUR	1,47

Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Balanced

Die Anteilsklassen I, P, R und ZZ des Teilfonds sind ausschüttend. Im Berichtszeitraum fanden folgende Ausschüttungen statt:

Teilfonds	Anteilsklasse	Ex-Tag	Ausschüttung je Anteil	
Assenagon I – Multi Asset Conservative	P EUR	17.11.2022	EUR	1,41
Assenagon I – Multi Asset Conservative	R EUR	17.11.2022	EUR	1,41

Besteuerung (Taxe d'abonnement)

Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Conservative

Der Teilfonds unterliegt einer Abonnementsteuer (Taxe d'abonnement) in Höhe von 0,01 % p. a. für die Anteilsklasse I und 0,05 % p. a. für die Anteilsklasse P, N und R, welche vierteljährlich auf der Grundlage des Gesamtnettovermögens am Ende des jeweiligen Quartals berechnet wird.

Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Balanced

Der Teilfonds unterliegt einer Abonnementsteuer (Taxe d'abonnement) in Höhe von 0,01 % p. a. für die Anteilsklassen I und ZZ (Anteilsklassen für institutionelle Anleger) sowie 0,05 % p. a. für die Anteilsklassen P und R welche vierteljährlich auf der Grundlage des Gesamtnettovermögens am Ende des jeweiligen Quartals berechnet wird.

Die Einkünfte des Fonds werden im Großherzogtum Luxemburg nicht mit Einkommen- oder Körperschaftsteuern belastet. Sie können jedoch etwaigen Quellensteuern oder anderen Steuern in Ländern unterliegen, in denen das Fondsvermögen investiert ist. Weder die Verwaltungsgesellschaft noch die Verwahrstelle werden Bescheinigungen über solche Steuern für einzelne oder alle Anteilhaber einholen.

Anleger können hinsichtlich der Zins- und Kapitalerträge einer individuellen Besteuerung unterliegen. Interessenten sollten sich über Gesetze und Verordnungen, die auf den Kauf, den Besitz und die Rücknahme von Anteilen Anwendung finden, informieren und sich gegebenenfalls beraten lassen.

Detaillierte Informationen bezüglich der Besteuerung von Fondsvermögen in Luxemburg können dem aktuellen Verkaufsprospekt entnommen werden.

Verwaltungsgebühren der KAG-fremden Zielfonds

Auf Anfrage ist am eingetragenen Sitz der Verwaltungsgesellschaft eine kostenfreie Aufstellung über die Verwaltungsgebühren der im Berichtszeitraum im Bestand gehaltenen Zielfonds, welche nicht von der KAG verwaltet wurden, erhältlich.

Hinweis zum Russland / Ukraine Konflikt

Im Februar 2022 kam es zum Ausbruch von kriegerischen Handlungen zwischen Russland und der Ukraine. Als Reaktion darauf hat der Westen weitgehende Sanktionen gegenüber Russland verhängt, welche verschiedene Bereiche wie Produktion, Lieferketten, Warenaustausch und Finanzmärkte betreffen. Der Handel für russische Wertpapiere und Fonds wurde im Zuge dessen ausgesetzt.

Die Teilfonds Assenagon I Multi Asset Conservative und Assenagon I - Multi Asset Balanced halten Anteile am Lyxor MSCI Russia UCITS ETF. Die Börsennotiz dieses Fonds wurde am 4. März 2022 ausgesetzt. Daraufhin beschloss das Valuation Committee von Assenagon Asset Management S.A., die Bewertung dieses Instruments bis zu einer Wiederaufnahme der Börsennotiz mit einem Wert von 0 anzusetzen.

Wichtige Ereignisse während des Berichtszeitraumes

Mit Wirkung zum 12. Dezember 2022 wurde Herr Jens Meiser in die Geschäftsführung der Verwaltungsgesellschaft aufgenommen.

Mit Wirkung zum 6. März 2023 wechselte die Register- und Transferstelle des Fonds von der European Depositary Bank SA zur Apex Fund Services S.A.

Wichtige Ereignisse nach Ende des Berichtszeitraumes

Es lagen keine wesentlichen Ereignisse nach dem Bilanzstichtag vor.

Nachhaltigkeitsbezogene Angaben

Der Fonds erfüllt die zum 10. März 2021 in Kraft getretenen Anforderungen des Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 (Offenlegungsverordnung). Dabei wurde bei aktiven Zielfonds-Investments ein best-in-class-Ansatz verfolgt, welcher im Jahres-Durchschnitt zu Fonds mit einer überdurchschnittlichen ESG-Ausprägung geführt hat. Auf Einzeltitel-Ebene bestehend aus einer Position im Bereich Energie, wurde eine Verbesserung im absoluten ESG-Score erreicht. Da sich das herangezogene Vergleichsuniversum lt. MSCI stärker verbessert hat, wurde aktiv ein Engagement-Prozess initiiert. Darüber hinaus wurden Unternehmen mit besonders schwerwiegenden Kontroversen (inkl. Verstößen gegen die Prinzipien des UN Global Compact) sowie mit signifikanten Umsatzanteilen in umstrittenen Geschäftsfeldern (inkl. einer Null-Toleranz-Schwelle für Emittenten mit Bezug zu geächteten Waffen) als Direktinvestments ausgeschlossen.

Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und deren Weiterverwendung

Am 23. Dezember 2015 wurde die Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung sowie zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 (SFTR) im Amtsblatt der Europäischen Union veröffentlicht.

Die SFTR regelt im Wesentlichen Verpflichtungen im Hinblick auf sogenannte "Wertpapierfinanzierungsgeschäfte" (WFG). Durch die SFTR werden für den Abschluss, die Änderung oder Beendigung von WFG neben den nach EMIR bereits bestehenden Reporting-Verpflichtungen (die aber für WFG grundsätzlich nicht anwendbar sind) zusätzliche Meldepflichten begründet.

Der Assenagon I – Multi Asset Conservative und der Assenagon I – Multi Asset Balanced unterhielten keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte oder Gesamttrendite-Swaps im abgelaufenen Berichtszeitraum. Die zusätzlichen Meldepflichten aus oben genannter Regulierung finden daher keine Anwendung.

Zusatzinformationen für Anleger in der Schweiz

Allgemein

Assenagon I ist ein Investmentfonds nach Luxemburger Recht, der als "Fonds Commun de Placement à Compartiments Multiples" aufgelegt wurde.

Vertreter in der Schweiz ist:
Carnegie Fund Services S.A.
11, rue du Général-Dufour
CH-1204 Genf

Zahlstelle in der Schweiz ist:
Banque Cantonale de Genève
17, Quai de l'Île
CH-1204 Genf

Bezugsort für maßgebliche Dokumente

Das Verwaltungsreglement sowie der Prospekt und das "Basisinformationsblatt", die Liste über die Aufstellung der Käufe und Verkäufe sowie der Jahres- und Halbjahresbericht des Fonds können in der Schweiz kostenlos bei den oben genannten Vertretern bezogen werden. Die Veröffentlichungen der Anteilspreise in der Schweiz erfolgen auf der elektronischen Plattform der Gesellschaft fundinfo AG (www.fundinfo.com).

Total Expense Ratio

Die Gesamtkostenquote (Total Expense Ratio oder "TER"), drückt das Verhältnis der Kosten und Gebühren (mit Ausnahme der Transaktionskosten) als Prozentsatz des durchschnittlichen Fondsvermögens innerhalb einer 12-Monats-Periode aus.

Die zusammengesetzte (synthetische) TER wird ausgewiesen, sofern der Gesamtanteil der Zielfonds größer gleich 10 % des Nettofondsvermögens ist und entspricht der Summe der TER des Dachfonds, abzüglich der in der Berichtsperiode vereinnahmten Rückvergütungen von Zielfonds, der anteilmäßigen TER der einzelnen Zielfonds, gewichtet nach deren Anteil am Nettovermögen des Dachfonds per Stichtag, sowie der effektiv bezahlten Ausgabe- und Rücknahmekommissionen der Zielfonds.

Assenagon I	Anteilsklasse	Total Expense Ratio*)	Synthetische Total Expense Ratio
Assenagon I – Multi Asset Conservative	I EUR	0,83 %	1,28 %
Assenagon I – Multi Asset Conservative	P EUR	1,36 %	1,81 %
Assenagon I – Multi Asset Conservative	R EUR	0,88 %	1,33 %
Assenagon I – Multi Asset Conservative	N EUR	1,62 %	2,08 %
Assenagon I – Multi Asset Balanced	I EUR	1,06 %	1,54 %
Assenagon I – Multi Asset Balanced	P EUR	1,50 %	2,97 %
Assenagon I – Multi Asset Balanced	R EUR	1,10 %	1,57 %
Assenagon I – Multi Asset Balanced	ZZ EUR	0,70 %	1,17 %

*) Die Total Expense Ratio im Halbjahresbericht setzt sich aus den Daten des Berichtshalbjahres und dem 2. Halbjahr des vorangegangenen Geschäftsjahres zusammen.

Die Berechnung und Offenlegung der Total Expense Ratio entspricht der AMAS-Richtlinie vom 16. Mai 2008 (Stand 5. August 2021).

Performance-Kennzahlen (Stand: 31. März 2023)

Assenagon I	Anteilklasse	31.03.2023	30.09.2022	30.09.2021
Assenagon I – Multi Asset Conservative	I EUR	4,31 %	-8,58 %	8,90 %
Assenagon I – Multi Asset Conservative	P EUR	4,00 %	-8,99 %	8,37 %
Assenagon I – Multi Asset Conservative	R EUR	4,30 %	-8,64 %	8,83 %
Assenagon I – Multi Asset Conservative	N EUR	3,88 %	-9,30 %	1,12 % ¹⁾
Assenagon I – Multi Asset Balanced	I EUR	5,37 %	-12,32 % ²⁾	-
Assenagon I – Multi Asset Balanced	P EUR	5,14 %	-12,66 % ²⁾	-
Assenagon I – Multi Asset Balanced	R EUR	5,37 %	-12,36 % ²⁾	-
Assenagon I – Multi Asset Balanced	ZZ EUR	5,56 %	-12,02 % ²⁾	-

Die historische Performance stellt keinen Indikator für die laufende oder zukünftige Performance dar. Die Performance-Daten lassen die bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen erhobenen Kommissionen unberücksichtigt.

¹⁾ Für den Zeitraum seit Erstausgabedatum am 20. April 2021 bis zum 30. September 2021.

²⁾ Für den Zeitraum seit Erstausgabedatum am 8. Dezember 2021 bis zum 30. September 2022.

assenagon

Assenagon Asset Management S.A.

Aerogolf Center, 1B, Heienhaff

1736 Senningerberg

Luxemburg

Telefon +352 27049-100

Telefax +352 27049-111

www.assenagon.com

© 2023